

平成31年2月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
(管理会社コード:13054)
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
問合せ先 経営企画部 岡 田 美 範
(TEL. 03-5555-4946)

上場ETF(管理会社:大和証券投資信託委託)に関する日々の開示事項 1/2

大和証券投資信託委託株式会社を管理会社として上場するETF銘柄について、以下のとおり平成31年2月20日現在の状況をご報告します。

上場ETF銘柄(23銘柄)

掲載番号	銘柄名	銘柄コード	上場取引所
1	ダイワ上場投信－日経225	1320	東
2	ダイワ上場投信－トピックス	1305	東
3	ダイワ上場投信－トピックス・コア30	1310	東
4	ダイワ上場投信－東証電気機器株価指数	1610	東
5	ダイワ上場投信－東証銀行業株価指数	1612	東
6	ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials	1585	東
7	ダイワ上場投信－JPX日経400	1599	東
8	ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス	1365	東
9	ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス	1366	東
10	ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数	1367	東
11	ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数	1368	東
12	ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス	1456	東
13	ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数	1457	東
14	ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス	1464	東
15	ダイワ上場投信－JPX日経400インバース・インデックス	1465	東
16	ダイワ上場投信－JPX日経400ダブルインバース・インデックス	1466	東
17	ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数	1479	東
18	ダイワ上場投信－東証REIT指数	1488	東
19	ダイワ上場投信－TOPIX高配当40指数	1651	東
20	ダイワ上場投信－MSCI日本株女性活躍指数(WIN)	1652	東
21	ダイワ上場投信－MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数	1653	東
22	ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index	1654	東
23	ダイワ上場投信－東証REIT Core指数	2528	東

*各銘柄の状況につきましては、次ページ以降をご参照ください。

なお、各銘柄名をクリックしていただくと、各銘柄の保有状況が表示されます。

以上

平成31年2月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1320)
問合せ先 経営企画部 岡 田 美 範
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信一日経225』に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信一日経225』の上場受益権口数
(平成31年2月20日 現在)

120,803,933 口

2. 『ダイワ上場投信一日経225』の純資産総額
(平成31年2月20日 現在)

2,663,062,302,938 円

3. 『ダイワ上場投信一日経225』の一口あたりの純資産額
(平成31年2月20日 現在)

22,044.5 円

4. 『ダイワ上場投信一日経225』の一口あたりの純資産額と
『日経平均株価』の終値の変動率に係る乖離率
(平成31年2月20日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成31年2月21日 現在)

[掲載番号:1]

ダイワ上場投信一日経225(設定ポートフォリオ)

本日をバスケット提示日とする追加設定日は下記のとおりですが、追加設定日前の受付日が受付停止日になっているため、バスケットの提示は行いません。

バスケット提示日 = 平成31年2月21日
追加設定日 = 平成31年2月27日

平成31年2月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1305)
問合せ先 経営企画部 岡 田 美 範
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信―トピックス』に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信―トピックス』の上場受益権口数
(平成31年2月20日 現在)

2,454,483,420 口

2. 『ダイワ上場投信―トピックス』の純資産総額
(平成31年2月20日 現在)

4,148,159,623,169 円

3. 『ダイワ上場投信―トピックス』の一口あたりの純資産額
(平成31年2月20日 現在)

1,690.03 円

4. 『ダイワ上場投信―トピックス』の一口あたりの純資産額と
『東証株価指数(TOPIX)』の終値の変動率に係る乖離率
(平成31年2月20日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成31年2月21日 現在)

[掲載番号:2]

ダイワ上場投信ートピックス(設定ポートフォリオ)

本日をバスケット提示日とする追加設定日は下記のとおりですが、追加設定日前の受付日が受付停止日になっているため、バスケットの提示は行いません。

バスケット提示日 = 平成31年2月21日
追加設定日 = 平成31年2月27日

平成31年2月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1310)
問合せ先 経営企画部 岡 田 美 範
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信ートピックス・コア30』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信ートピックス・コア30』の上場受益権口数
(平成31年2月20日 現在)

2,603,675 口

2. 『ダイワ上場投信ートピックス・コア30』の純資産総額
(平成31年2月20日 現在)

1,898,836,573 円

3. 『ダイワ上場投信ートピックス・コア30』の一口あたりの純資産額
(平成31年2月20日 現在)

729.291 円

4. 『ダイワ上場投信ートピックス・コア30』の一口あたりの純資産額と
『TOPIX Core30 指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成31年2月20日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成31年2月21日 現在)

[掲載番号:3]

ダイワ上場投信ートピックス・コア30(設定ポートフォリオ)

本日をバスケット提示日とする追加設定日は下記のとおりですが、追加設定日前の受付日が受付停止日になっているため、バスケットの提示は行いません。

バスケット提示日 = 平成31年2月21日
追加設定日 = 平成31年2月27日

平成31年2月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1610)
問合せ先 経営企画部 岡 田 美 範
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数』の上場受益権口数
(平成31年2月20日 現在)

1,023,700 口

2. 『ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数』の純資産総額
(平成31年2月20日 現在)

2,285,788,362 円

3. 『ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数』の一口あたりの純資産額
(平成31年2月20日 現在)

2,232.869 円

4. 『ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数』の一口あたりの純資産額と
『東証電気機器株価指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成31年2月20日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成31年2月21日 現在)

[掲載番号:4]

ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数(設定ポートフォリオ)

本日をバスケット提示日とする追加設定日は下記のとおりですが、追加設定日前の受付日が受付停止日になっているため、バスケットの提示は行いません。

バスケット提示日 = 平成31年2月21日
追加設定日 = 平成31年2月27日

平成31年2月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1612)
問合せ先 経営企画部 岡 田 美 範
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数』の上場受益権口数
(平成31年2月20日 現在)

4,673,862 口

2. 『ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数』の純資産総額
(平成31年2月20日 現在)

691,597,826 円

3. 『ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数』の一口あたりの純資産額
(平成31年2月20日 現在)

147.971 円

4. 『ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数』の一口あたりの純資産額と
『東証銀行業株価指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成31年2月20日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成31年2月21日 現在)

ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
単位 = 1 バスケット	1	7150 島根銀行	100
銘柄数 = 82	2	7161 じもとホールディングス	1,700
バスケット提示日 = 平成31年2月21日	3	7167 めぶきフィナンシャルグループ	12,800
追加設定日 = 平成31年2月27日	4	7173 東京きらぼしフィナンシャルグループ	300
	5	7180 九州フィナンシャルグループ	4,100
	6	7182 ゆうちょ銀行	7,000
	7	7184 富山第一銀行	600
	8	7186 コンコルディア・フィナンシャルグループ	15,700
	9	7189 西日本フィナンシャルホールディングス	1,600
	10	7321 関西みらいフィナンシャルグループ	1,200
	11	7322 三十三フィナンシャルグループ	200
	12	7327 第四北越フィナンシャルグループ	400
	13	8303 新生銀行	1,800
	14	8304 あおぞら銀行	1,400
	15	8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	172,200
	16	8308 りそなホールディングス	27,100
	17	8309 三井住友トラスト・ホールディングス	4,900
	18	8316 三井住友フィナンシャルグループ	17,400
	19	8331 千葉銀行	8,800
	20	8334 群馬銀行	4,900
	21	8336 武蔵野銀行	400
	22	8337 千葉興業銀行	700
	23	8338 筑波銀行	1,000
	24	8341 七十七銀行	800
	25	8342 青森銀行	200
	26	8343 秋田銀行	200
	27	8344 山形銀行	300
	28	8345 岩手銀行	200
	29	8346 東邦銀行	2,200
	30	8349 東北銀行	100
	31	8350 みちのく銀行	200
	32	8354 ふくおかフィナンシャルグループ	2,000
	33	8355 静岡銀行	6,200
	34	8356 十六銀行	300
	35	8358 スルガ銀行	2,500
	36	8359 八十二銀行	4,500
	37	8360 山梨中央銀行	300
	38	8361 大垣共立銀行	400
	39	8362 福井銀行	200
	40	8363 北國銀行	300
	41	8364 清水銀行	100
	42	8366 滋賀銀行	500
	43	8367 南都銀行	300
	44	8368 百五銀行	2,200
	45	8369 京都銀行	900
	46	8370 紀陽銀行	900
	47	8377 ほくほくフィナンシャルグループ	1,600
	48	8379 広島銀行	3,600
	49	8381 山陰合同銀行	1,500
	50	8382 中国銀行	1,600

ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
51	8383	鳥取銀行	100
52	8385	伊予銀行	3,300
53	8386	百十四銀行	300
54	8387	四国銀行	400
55	8388	阿波銀行	400
56	8392	大分銀行	200
57	8393	宮崎銀行	200
58	8395	佐賀銀行	200
59	8396	十八銀行	200
60	8397	沖縄銀行	200
61	8399	琉球銀行	600
62	8410	セブン銀行	8,400
63	8411	みずほフィナンシャルグループ	336,000
64	8416	高知銀行	100
65	8418	山口フィナンシャルグループ	3,100
66	8521	長野銀行	100
67	8522	名古屋銀行	200
68	8524	北洋銀行	3,700
69	8527	愛知銀行	100
70	8530	中京銀行	100
71	8537	大光銀行	100
72	8541	愛媛銀行	300
73	8542	トマト銀行	100
74	8544	京葉銀行	1,100
75	8550	栃木銀行	1,300
76	8551	北日本銀行	100
77	8558	東和銀行	400
78	8562	福島銀行	200
79	8563	大東銀行	100
80	8600	トモニホールディングス	1,900
81	8713	フィデアホールディングス	2,400
82	8714	池田泉州ホールディングス	2,600

平成31年2月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1585)
問合せ先 経営企画部 岡 田 美 範
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』の上場受益権口数
(平成31年2月20日 現在)

20,093,278 口

2. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』の純資産総額
(平成31年2月20日 現在)

24,958,917,860 円

3. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』の一口あたりの純資産額
(平成31年2月20日 現在)

1,242.153 円

4. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』の一口あたりの純資産額と
『TOPIX Ex-Financials』の終値の変動率に係る乖離率
(平成31年2月20日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成31年2月21日 現在)

[掲載番号:6]

ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials (設定ポートフォリオ)

本日をバスケット提示日とする追加設定日は下記のとおりですが、追加設定日前の受付日が受付停止日になっているため、バスケットの提示は行いません。

バスケット提示日 = 平成31年2月21日
追加設定日 = 平成31年2月27日

平成31年2月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1599)
問合せ先 経営企画部 岡 田 美 範
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－JPX日経400』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の上場受益権口数
(平成31年2月20日 現在)

14,200,652 口

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の純資産総額
(平成31年2月20日 現在)

205,457,772,995 円

3. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の一口あたりの純資産額
(平成31年2月20日 現在)

14,468.193 円

4. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の一口あたりの純資産額と
『JPX日経インデックス400』の終値の変動率に係る乖離率
(平成31年2月20日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成31年2月21日 現在)

[掲載番号:7]

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

本日をバスケット提示日とする追加設定日は下記のとおりですが、追加設定日前の受付日が受付停止日になっているため、バスケットの提示は行いません。

バスケット提示日 = 平成31年2月21日
追加設定日 = 平成31年2月27日

平成31年2月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1365)
問合せ先 経営企画部 岡 田 美 範
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス』の上場受益権口数
(平成31年2月20日 現在)

885,000 口

2. 『ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス』の純資産総額
(平成31年2月20日 現在)

12,247,719,823 円

3. 『ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス』の一口あたりの純資産額
(平成31年2月20日 現在)

13,839.23 円

4. 『ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス』の一口あたりの純資産額と
『日経平均レバレッジ・インデックス』の終値の変動率に係る乖離率
(平成31年2月20日 現在)

-0.09 %

●「日経平均レバレッジ・インデックス」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「日経平均レバレッジ・インデックス」は原指標の「日経平均株価」の変動率の「2倍」の値動きになる指数で、「日経平均株価」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な正相関ではないため、複数日以上での計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「日経平均株価」の変動率の「2倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「日経平均株価」の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、「日経平均株価」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「日経平均レバレッジ・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率と日経平均レバレッジ・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、日経平均株価の値動きと日経平均先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率を日経平均レバレッジ・インデックスの変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成31年2月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1366)
問合せ先 経営企画部 岡 田 美 範
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス』の上場受益権口数
(平成31年2月20日 現在)

1,990,000 口

2. 『ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス』の純資産総額
(平成31年2月20日 現在)

6,201,722,415 円

3. 『ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス』の一口あたりの純資産額
(平成31年2月20日 現在)

3,116.44 円

4. 『ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス』の一口あたりの純資産額と
『日経平均ダブルインバース・インデックス』の終値の変動率に係る乖離率
(平成31年2月20日 現在)

0.08 %

●「日経平均ダブルインバース・インデックス」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「日経平均ダブルインバース・インデックス」は原指標の「日経平均株価」の変動率の「-2倍」(マイナス2倍)の値動きになる指数で、「日経平均株価」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上の計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「日経平均株価」の変動率の「-2倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「日経平均株価」の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、「日経平均株価」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「日経平均ダブルインバース・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率と日経平均ダブルインバース・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、日経平均株価の値動きと日経平均先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率を日経平均ダブルインバース・インデックスの変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成31年2月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1367)
問合せ先 経営企画部 岡 田 美 範
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数』の上場受益権口数
(平成31年2月20日 現在)

184,000 口

2. 『ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数』の純資産総額
(平成31年2月20日 現在)

2,312,419,014 円

3. 『ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数』の一口あたりの純資産額
(平成31年2月20日 現在)

12,567.49 円

4. 『ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数』の一口あたりの純資産額と
『TOPIXレバレッジ(2倍)指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成31年2月20日 現在)

0.13 %

●「TOPIXレバレッジ(2倍)指数」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「TOPIXレバレッジ(2倍)指数」は原指標の「TOPIX」の変動率の「2倍」の値動きになる指数で、「TOPIX」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な正相関ではないため、複数日以上での計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「TOPIX」の変動率の「2倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「TOPIX」の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、「TOPIX」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「TOPIXレバレッジ(2倍)指数」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率とTOPIXレバレッジ(2倍)指数の変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、TOPIXの値動きとTOPIX先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をTOPIXレバレッジ(2倍)指数の変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成31年2月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1368)
問合せ先 経営企画部 岡 田 美 範
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』の上場受益権口数
(平成31年2月20日 現在)

500,000 口

2. 『ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』の純資産総額
(平成31年2月20日 現在)

1,834,892,392 円

3. 『ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』の一口あたりの純資産額
(平成31年2月20日 現在)

3,669.78 円

4. 『ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』の一口あたりの純資産額と
『TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成31年2月20日 現在)

-0.14 %

●「TOPIXダブルインバース(-2倍)指数」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「TOPIXダブルインバース(-2倍)指数」は原指標の「TOPIX」の変動率の「-2倍」(マイナス2倍)の値動きになる指数で、「TOPIX」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「TOPIX」の変動率の「-2倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「TOPIX」の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、「TOPIX」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「TOPIXダブルインバース(-2倍)指数」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率とTOPIXダブルインバース(-2倍)指数の変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、TOPIXの値動きとTOPIX先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をTOPIXダブルインバース(-2倍)指数の変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成31年2月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1456)
問合せ先 経営企画部 岡 田 美 範
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス』の上場受益権口数
(平成31年2月20日 現在)

6,441,268 口

2. 『ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス』の純資産総額
(平成31年2月20日 現在)

45,366,565,265 円

3. 『ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス』の一口あたりの純資産額
(平成31年2月20日 現在)

7,043.11 円

4. 『ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス』の一口あたりの純資産額と
『日経平均インバース・インデックス』の終値の変動率に係る乖離率
(平成31年2月20日 現在)

0.04 %

●「日経平均インバース・インデックス」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「日経平均インバース・インデックス」は原指標の「日経平均株価」の変動率の「-1倍」(マイナス1倍)の値動きになる指数で、「日経平均株価」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-1倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上での計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「日経平均株価」の変動率の「-1倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「日経平均株価」の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、「日経平均株価」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。

【「日経平均インバース・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率と日経平均インバース・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、日経平均株価の値動きと日経平均先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率を日経平均インバース・インデックスの変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成31年2月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1457)
問合せ先 経営企画部 岡 田 美 範
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数』の上場受益権口数
(平成31年2月20日 現在)

1,601,600 口

2. 『ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数』の純資産総額
(平成31年2月20日 現在)

12,262,369,976 円

3. 『ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数』の一口あたりの純資産額
(平成31年2月20日 現在)

7,656.32 円

4. 『ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数』の一口あたりの純資産額と
『TOPIXインバース(-1倍)指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成31年2月20日 現在)

-0.07 %

●「TOPIXインバース(-1倍)指数」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「TOPIXインバース(-1倍)指数」は原指標の「TOPIX」の変動率の「-1倍」(マイナス1倍)の値動きになる指数で、「TOPIX」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-1倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上での計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「TOPIX」の変動率の「-1倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「TOPIX」の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、「TOPIX」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。

【「TOPIXインバース(-1倍)指数」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率とTOPIXインバース(-1倍)指数の変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、TOPIXの値動きと日経平均先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をTOPIXインバース(-1倍)指数の変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成31年2月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1464)
問合せ先 経営企画部 岡 田 美 範
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス』の上場受益権口数
(平成31年2月20日 現在)

60,000 口

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス』の純資産総額
(平成31年2月20日 現在)

585,956,344 円

3. 『ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス』の一口あたりの純資産額
(平成31年2月20日 現在)

9,765.94 円

4. 『ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス』の一口あたりの純資産額と
『JPX日経400レバレッジ・インデックス』の終値の変動率に係る乖離率
(平成31年2月20日 現在)

0.12 %

●「JPX日経400レバレッジ・インデックス」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「JPX日経400レバレッジ・インデックス」は原指標の「JPX日経インデックス400」の変動率の「2倍」の値動きになる指数で、「JPX日経インデックス400」の1日の変化率（前日終値と当日終値とを比較して算出）を「2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な正相関ではないため、複数日以上 of 計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「JPX日経インデックス400」の変動率の「2倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「JPX日経インデックス400」の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、「JPX日経インデックス400」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「JPX日経400レバレッジ・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率とJPX日経400レバレッジ・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、JPX日経インデックス400の値動きとJPX日経インデックス400先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をJPX日経400レバレッジ・インデックスの変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成31年2月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1465)
問合せ先 経営企画部 岡 田 美 範
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－JPX日経400インバース・インデックス』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－JPX日経400インバース・インデックス』の上場受益権口数
(平成31年2月20日 現在)

402,000 口

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400インバース・インデックス』の純資産総額
(平成31年2月20日 現在)

3,046,324,521 円

3. 『ダイワ上場投信－JPX日経400インバース・インデックス』の一口あたりの純資産額
(平成31年2月20日 現在)

7,577.92 円

4. 『ダイワ上場投信－JPX日経400インバース・インデックス』の一口あたりの純資産額と
『JPX日経400インバース・インデックス』の終値の変動率に係る乖離率
(平成31年2月20日 現在)

-0.06 %

●「JPX日経400インバース・インデックス」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「JPX日経400インバース・インデックス」は原指標の「JPX日経インデックス400」の変動率の「-1倍」(マイナス1倍)の値動きになる指数で、「JPX日経インデックス400」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-1倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上での計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「JPX日経インデックス400」の変動率の「-1倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「JPX日経インデックス400」の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、「JPX日経インデックス400」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。

【「JPX日経400インバース・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率とJPX日経400インバース・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、JPX日経インデックス400の値動きとJPX日経インデックス400先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をJPX日経400インバース・インデックスの変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成31年2月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1466)
問合せ先 経営企画部 岡 田 美 範
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－JPX日経400ダブルインバース・インデックス』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－JPX日経400ダブルインバース・インデックス』の上場受益権口数
(平成31年2月20日 現在)

57,900 口

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400ダブルインバース・インデックス』の純資産総額
(平成31年2月20日 現在)

291,110,866 円

3. 『ダイワ上場投信－JPX日経400ダブルインバース・インデックス』の一口あたりの純資産額
(平成31年2月20日 現在)

5,027.82 円

4. 『ダイワ上場投信－JPX日経400ダブルインバース・インデックス』の一口あたりの純資産額と
『JPX日経400ダブルインバース・インデックス』の終値の変動率に係る乖離率
(平成31年2月20日 現在)

-0.13 %

●「JPX日経400ダブルインバース・インデックス」に内在する性質に関する注意点
対象指標とする「JPX日経400ダブルインバース・インデックス」は原指標の「JPX日経インデックス400」の変動率の「-2倍」(マイナス2倍)の値動きになる指数で、「JPX日経インデックス400」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上
の計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「JPX日経インデックス400」の変動率の「-2倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「JPX日経インデックス400」の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性がありますが、一般に、「JPX日経インデックス400」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逡減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逡減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「JPX日経400ダブルインバース・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】
ファンドの基準価額の変動率とJPX日経400ダブルインバース・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、JPX日経インデックス400の値動きとJPX日経インデックス400先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をJPX日経400ダブルインバース・インデックスの変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成31年2月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1479)
問合せ先 経営企画部 岡 田 美 範
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数』の上場受益権口数
(平成31年2月20日 現在)

2,917,129 口

2. 『ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数』の純資産総額
(平成31年2月20日 現在)

54,537,803,489 円

3. 『ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数』の一口あたりの純資産額
(平成31年2月20日 現在)

18,695.71 円

4. 『ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数』の一口あたりの純資産額と
『MSCI日本株人材設備投資指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成31年2月20日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成31年2月21日 現在)

ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
単位 = 1 バスケット	1	1802 大林組	3,800	
銘柄数 = 150	2	1925 大和ハウス工業	5,100	
バスケット提示日 = 平成31年2月21日	3	2331 総合警備保障	500	
追加設定日 = 平成31年2月27日	4	2371 カカクコム	1,600	
	5	2433 博報堂DYホールディングス	1,700	
※「○」で表示した銘柄は	6	2502 アサヒグループホールディングス	1,500	
現金拠出で対応する銘柄です。	7	2503 キリンホールディングス	5,100	
	8	2587 サントリー食品インターナショナル	1,100	
	9	2702 日本マクドナルドホールディングス	300	
	10	2802 味の素	2,200	
	11	3003 ヒューリック	1,000	
	12	3401 帝人	1,000	
	13	3402 東レ	5,000	
	14	3405 クラレ	1,900	
	15	3407 旭化成	8,500	
	16	3436 SUMCO	900	
	17	4004 昭和電工	400	
	18	4005 住友化学	10,400	
	19	4118 カネカ	200	
	20	4151 協和発酵キリン	1,500	
	21	4182 三菱瓦斯化学	400	
	22	4183 三井化学	600	
	23	4188 三菱ケミカルホールディングス	7,300	
	24	4217 日立化成	600	
	25	4307 野村総合研究所	1,000	
	26	4324 電通	800	
	27	4452 花王	5,400	
	28	4502 武田薬品工業	1,800	
	29	4503 アステラス製薬	21,100	
	30	4506 大日本住友製薬	1,100	
	31	4507 塩野義製薬	3,100	
	32	4508 田辺三菱製薬	1,200	
	33	4519 中外製薬	1,500	
	34	4523 エーザイ	1,600	
	35	4528 小野薬品工業	1,900	
	36	4530 久光製薬	300	○
	37	4536 参天製薬	2,500	
	38	4543 テルモ	2,400	
	39	4568 第一三共	2,000	
	40	4578 大塚ホールディングス	1,900	
	41	4581 大正製薬ホールディングス	200	
	42	4689 ヤフー	26,700	
	43	4704 トレンドマイクロ	1,400	
	44	4716 日本オラクル	500	
	45	4751 サイバーエージェント	800	
	46	4901 富士フイルムホールディングス	900	
	47	4902 コニカミノルタ	1,600	
	48	4927 ポーラ・オルビスホールディングス	1,000	
	49	5002 昭和シェル石油	800	
	50	5020 JXTGホールディングス	14,600	

ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
	51	5101 横浜ゴム	500	
	52	5108 ブリヂストン	5,500	
	53	5233 太平洋セメント	600	
	54	5333 日本碍子	1,600	
	55	5334 日本特殊陶業	1,100	
	56	5401 新日鐵住金	3,000	
	57	5406 神戸製鋼所	300	
	58	5486 日立金属	1,200	
	59	5802 住友電気工業	3,900	
	60	5938 LIXILグループ	200	
	61	5947 リンナイ	200	
	62	6098 リクルートホールディングス	3,500	
	63	6146 ディスコ	300	
	64	6201 豊田自動織機	600	
	65	6301 小松製作所	7,700	
	66	6305 日立建機	300	
	67	6326 クボタ	5,300	
	68	6383 ダイフク	400	
	69	6448 ブラザー工業	1,200	
	70	6460 セガサミーホールディングス	400	
	71	6471 日本精工	1,700	
	72	6473 ジェイテクト	1,000	
	73	6479 ミネベアミツミ	2,200	
	74	6501 日立製作所	7,000	
	75	6503 三菱電機	9,100	
	76	6504 富士電機	700	
	77	6506 安川電機	2,300	○
	78	6594 日本電産	800	
	79	6645 オムロン	1,500	
	80	6701 日本電気	700	
	81	6723 ルネサスエレクトロニクス	4,100	
	82	6724 セイコーエプソン	1,300	
	83	6752 パナソニック	12,700	
	84	6758 ソニー	9,600	
	85	6861 キーエンス	900	
	86	6869 シスメックス	1,700	
	87	6902 デンソー	2,400	
	88	6952 カシオ計算機	1,100	
	89	6963 ローム	400	
	90	6971 京セラ	1,100	
	91	6981 村田製作所	1,200	
	92	7011 三菱重工業	500	
	93	7012 川崎重工業	600	
	94	7013 IHI	400	
	95	7167 めぶきフィナンシャルグループ	2,200	
	96	7182 ゆうちょ銀行	1,600	
	97	7203 トヨタ自動車	8,400	
	98	7205 日野自動車	1,500	
	99	7261 マツダ	2,200	
	100	7270 SUBARU	4,500	

ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
	101	7282 豊田合成	300	
	102	7731 ニコン	1,500	
	103	7733 オリンパス	800	
	104	7751 キヤノン	5,100	
	105	7752 リコー	1,000	
	106	7912 大日本印刷	400	
	107	7974 任天堂	500	
	108	8031 三井物産	4,300	
	109	8035 東京エレクトロン	500	
	110	8058 三菱商事	3,000	
	111	8113 ユニ・チャーム	2,900	
	112	8267 イオン	1,700	○
	113	8304 あおぞら銀行	400	
	114	8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	29,900	
	115	8308 りそなホールディングス	7,500	
	116	8309 三井住友トラスト・ホールディングス	800	
	117	8316 三井住友フィナンシャルグループ	2,900	
	118	8410 セブン銀行	5,100	
	119	8411 みずほフィナンシャルグループ	72,200	
	120	8473 SBIホールディングス	800	
	121	8570 イオンフィナンシャルサービス	300	
	122	8591 オリックス	7,800	
	123	8593 三菱UFJリース	800	
	124	8601 大和証券グループ本社	3,600	
	125	8604 野村ホールディングス	8,000	
	126	8630 SOMPOホールディングス	1,400	
	127	8697 日本取引所グループ	6,400	
	128	8725 MS&ADインシュアランスグループホールディングス	2,100	
	129	8750 第一生命ホールディングス	4,400	
	130	8766 東京海上ホールディングス	2,800	
	131	8795 T&Dホールディングス	3,200	
	132	8801 三井不動産	3,300	
	133	8802 三菱地所	3,600	
	134	8905 イオンモール	600	○
	135	9005 東京急行電鉄	2,100	
	136	9201 日本航空	600	
	137	9202 ANAホールディングス	400	
	138	9432 日本電信電話	3,000	
	139	9433 KDDI	12,600	
	140	9437 NTTドコモ	9,600	
	141	9502 中部電力	1,000	
	142	9506 東北電力	600	
	143	9508 九州電力	800	
	144	9531 東京瓦斯	1,800	
	145	9532 大阪瓦斯	1,300	
	146	9602 東宝	600	○
	147	9613 エヌ・ティ・ティ・データ	2,900	
	148	9783 ベネッセホールディングス	200	
	149	9831 ヤマダ電機	2,200	
	150	9984 ソフトバンクグループ	1,000	

平成31年2月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1488)
問合せ先 経営企画部 岡 田 美 範
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－東証REIT指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－東証REIT指数』の上場受益権口数
(平成31年2月20日 現在)

43,728,142 口

2. 『ダイワ上場投信－東証REIT指数』の純資産総額
(平成31年2月20日 現在)

82,920,949,631 円

3. 『ダイワ上場投信－東証REIT指数』の一口あたりの純資産額
(平成31年2月20日 現在)

1,896.283 円

4. 『ダイワ上場投信－東証REIT指数』の一口あたりの純資産額と
『東証REIT指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成31年2月20日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成31年2月21日 現在)

[掲載番号:18]

ダイワ上場投信－東証REIT指数(設定ポートフォリオ)

本日をバスケット提示日とする追加設定日は下記のとおりですが、追加設定日前の受付日が受付停止日になっているため、バスケットの提示は行いません。

バスケット提示日 = 平成31年2月21日
追加設定日 = 平成31年2月27日

平成31年2月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1651)
問合せ先 経営企画部 岡 田 美 範
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－TOPIX高配当40指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－TOPIX高配当40指数』の上場受益権口数
(平成31年2月20日 現在)

13,572,266 口

2. 『ダイワ上場投信－TOPIX高配当40指数』の純資産総額
(平成31年2月20日 現在)

13,405,169,733 円

3. 『ダイワ上場投信－TOPIX高配当40指数』の一口あたりの純資産額
(平成31年2月20日 現在)

987.688 円

4. 『ダイワ上場投信－TOPIX高配当40指数』の一口あたりの純資産額と
『TOPIX高配当40指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成31年2月20日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成31年2月21日 現在)

ダイワ上場投信－TOPIX高配当40指数(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
単位 = 1 バスケット	1	1878 大東建託	100
銘柄数 = 40	2	1925 大和ハウス工業	600
バスケット提示日 = 平成31年2月21日	3	1928 積水ハウス	700
追加設定日 = 平成31年2月27日	4	2914 日本たばこ産業	1,100
	5	4188 三菱ケミカルホールディングス	1,300
	6	4502 武田薬品工業	1,200
	7	4503 アステラス製薬	1,800
	8	5020 JXTGホールディングス	3,200
	9	5108 プリヂストーン	600
	10	5401 新日鐵住金	900
	11	5411 ジェイ エフ イー ホールディングス	500
	12	6902 デンソー	400
	13	7011 三菱重工業	300
	14	7201 日産自動車	2,300
	15	7202 いすゞ自動車	600
	16	7203 トヨタ自動車	700
	17	7261 マツダ	600
	18	7267 本田技研工業	1,400
	19	7270 SUBARU	600
	20	7751 キヤノン	1,000
	21	8001 伊藤忠商事	1,300
	22	8002 丸紅	1,900
	23	8031 三井物産	1,600
	24	8035 東京エレクトロン	100
	25	8053 住友商事	1,100
	26	8058 三菱商事	1,300
	27	8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,000
	28	8308 りそなホールディングス	2,100
	29	8309 三井住友トラスト・ホールディングス	400
	30	8316 三井住友フィナンシャルグループ	1,100
	31	8411 みずほフィナンシャルグループ	25,700
	32	8591 オリックス	1,300
	33	8601 大和証券グループ本社	1,500
	34	8604 野村ホールディングス	3,300
	35	8725 MS&ADインシュアランスグループホールディングス	500
	36	8750 第一生命ホールディングス	1,100
	37	8766 東京海上ホールディングス	700
	38	9201 日本航空	300
	39	9433 KDDI	1,700
	40	9437 NTTドコモ	1,400

平成31年2月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1652)
問合せ先 経営企画部 岡 田 美 範
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－MSCI日本株女性活躍指数(WIN)』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－MSCI日本株女性活躍指数(WIN)』の上場受益権口数
(平成31年2月20日 現在)

657,700 口

2. 『ダイワ上場投信－MSCI日本株女性活躍指数(WIN)』の純資産総額
(平成31年2月20日 現在)

1,276,318,437 円

3. 『ダイワ上場投信－MSCI日本株女性活躍指数(WIN)』の一口あたりの純資産額
(平成31年2月20日 現在)

1,940.578 円

4. 『ダイワ上場投信－MSCI日本株女性活躍指数(WIN)』の一口あたりの純資産額と
『MSCI日本株女性活躍指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成31年2月20日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成31年2月21日 現在)

ダイワ上場投信－MSCI日本株女性活躍指数(WIN) (設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
単位 = 1 バスケット	1	1801 大成建設	200	
銘柄数 = 131	2	1802 大林組	300	
バスケット提示日 = 平成31年2月21日	3	1803 清水建設	200	
追加設定日 = 平成31年2月27日	4	1812 鹿島建設	100	
	5	1893 五洋建設	100	
※「○」で表示した銘柄は	6	1928 積水ハウス	300	
現金拠出で対応する銘柄です。	7	2229 カルビー	100	
	8	2371 カカココム	200	
	9	2413 エムスリー	400	
	10	2502 アサヒグループホールディングス	100	
	11	2503 キリンホールディングス	200	
	12	2587 サントリー食品インターナショナル	100	
	13	2768 双日	400	
	14	2784 アルフレッサ ホールディングス	100	
	15	2801 キッコーマン	100	
	16	2802 味の素	100	
	17	2871 ニチレイ	100	
	18	3003 ヒューリック	100	
	19	3086 J. フロント リテイリング	100	○
	20	3092 ZOZO	200	
	21	3099 三越伊勢丹ホールディングス	100	
	22	3289 東急不動産ホールディングス	100	
	23	3401 帝人	100	
	24	3402 東レ	500	
	25	3405 クラレ	200	
	26	3407 旭化成	1,200	
	27	3861 王子ホールディングス	200	
	28	4005 住友化学	1,000	
	29	4151 協和発酵キリン	100	
	30	4185 JSR	100	
	31	4188 三菱ケミカルホールディングス	900	
	32	4204 積水化学工業	200	
	33	4205 日本ゼオン	100	
	34	4217 日立化成	100	
	35	4272 日本化薬	100	
	36	4307 野村総合研究所	100	
	37	4452 花王	500	
	38	4502 武田薬品工業	200	
	39	4503 アステラス製薬	1,400	
	40	4506 大日本住友製薬	100	
	41	4507 塩野義製薬	300	
	42	4519 中外製薬	100	
	43	4523 エーザイ	100	
	44	4536 参天製薬	100	
	45	4568 第一三共	100	
	46	4578 大塚ホールディングス	100	
	47	4661 オリエンタルランド	100	
	48	4689 ヤフー	2,000	
	49	4716 日本オラクル	100	
	50	4739 伊藤忠テクノソリューションズ	100	

ダイワ上場投信－MSCI日本株女性活躍指数(WIN) (設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
51	4755	楽天	400	
52	4901	富士フイルムホールディングス	100	
53	4902	コニカミノルタ	100	
54	4911	資生堂	300	
55	4912	ライオン	200	
56	4927	ポーラ・オルビスホールディングス	100	
57	5002	昭和シェル石油	200	
58	5020	JXTGホールディングス	1,500	
59	5108	ブリヂストン	400	
60	5332	TOTO	100	
61	5333	日本碍子	100	
62	5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	100	
63	5486	日立金属	100	
64	6005	三浦工業	100	
65	6098	リクルートホールディングス	1,000	
66	6268	ナブテスコ	100	
67	6301	小松製作所	600	
68	6326	クボタ	400	
69	6367	ダイキン工業	200	
70	6479	ミネベアミツミ	300	
71	6501	日立製作所	500	
72	6503	三菱電機	1,100	
73	6504	富士電機	100	
74	6594	日本電産	100	
75	6645	オムロン	100	
76	6724	セイコーエプソン	100	
77	6770	アルプスアルパイン	100	
78	6857	アドバンテスト	100	
79	6952	カシオ計算機	100	
80	6988	日東電工	100	
81	7182	ゆうちょ銀行	100	
82	7203	トヨタ自動車	800	
83	7211	三菱自動車工業	200	
84	7270	SUBARU	300	
85	7276	小糸製作所	100	
86	7459	メディアパルホールディングス	100	
87	7731	ニコン	100	
88	7741	HOYA	300	
89	7751	キヤノン	300	
90	7752	リコー	100	
91	7762	シチズン時計	100	
92	7832	バンダイナムコホールディングス	200	
93	7911	凸版印刷	100	
94	7912	大日本印刷	100	
95	7951	ヤマハ	100	
96	7956	ビジョン	100	
97	8002	丸紅	700	
98	8031	三井物産	300	
99	8053	住友商事	300	
100	8058	三菱商事	200	

ダイワ上場投信－MSCI日本株女性活躍指数(WIN) (設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
101	8267	イオン	100	○
102	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,700	
103	8308	りそなホールディングス	1,500	
104	8316	三井住友フィナンシャルグループ	300	
105	8331	千葉銀行	400	
106	8355	静岡銀行	200	
107	8379	広島銀行	100	
108	8411	みずほフィナンシャルグループ	5,500	
109	8591	オリックス	800	
110	8601	大和証券グループ本社	400	
111	8604	野村ホールディングス	700	
112	8630	SOMPOホールディングス	300	
113	8697	日本取引所グループ	800	
114	8725	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	300	
115	8750	第一生命ホールディングス	700	
116	8766	東京海上ホールディングス	500	
117	8795	T&Dホールディングス	500	
118	8801	三井不動産	400	
119	8802	三菱地所	300	
120	8848	レオパレス21	100	
121	8905	イオンモール	100	○
122	9005	東京急行電鉄	100	
123	9201	日本航空	100	
124	9202	ANAホールディングス	100	
125	9433	KDDI	1,200	
126	9437	NTTドコモ	900	
127	9502	中部電力	100	
128	9531	東京瓦斯	400	
129	9532	大阪瓦斯	300	
130	9735	セコム	100	
131	9843	ニトリホールディングス	100	

平成31年2月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1653)
問合せ先 経営企画部 岡 田 美 範
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数』の上場受益権口数
(平成31年2月20日 現在)

1,487,246 口

2. 『ダイワ上場投信－MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数』の純資産総額
(平成31年2月20日 現在)

2,864,021,908 円

3. 『ダイワ上場投信－MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数』の一口あたりの純資産額
(平成31年2月20日 現在)

1,925.722 円

4. 『ダイワ上場投信－MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数』の一口あたりの純資産額と
『MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成31年2月20日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成31年2月21日 現在)

[掲載番号:21]

ダイワ上場投信－MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数(設定ポートフォリオ)

本日をバスケット提示日とする追加設定日は下記のとおりですが、追加設定日前の受付日が受付停止日になっているため、バスケットの提示は行いません。

バスケット提示日 = 平成31年2月21日
追加設定日 = 平成31年2月27日

平成31年2月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1654)
問合せ先 経営企画部 岡 田 美 範
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index』の上場受益権口数
(平成31年2月20日 現在)

1,719,790 口

2. 『ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index』の純資産総額
(平成31年2月20日 現在)

2,064,025,579 円

3. 『ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index』の一口あたりの純資産額
(平成31年2月20日 現在)

1,200.161 円

4. 『ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index』の一口あたりの純資産額と
『FTSE Blossom Japan Index』の終値の変動率に係る乖離率
(平成31年2月20日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成31年2月21日 現在)

[掲載番号:22]

ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index(設定ポートフォリオ)

本日をバスケット提示日とする追加設定日は下記のとおりですが、追加設定日前の受付日が受付停止日になっているため、バスケットの提示は行いません。

バスケット提示日 = 平成31年2月21日
追加設定日 = 平成31年2月27日

平成31年2月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 2528)
問合せ先 経営企画部 岡 田 美 範
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－東証REIT Core指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－東証REIT Core指数』の上場受益権口数
(平成31年2月20日 現在)

3,715,630 口

2. 『ダイワ上場投信－東証REIT Core指数』の純資産総額
(平成31年2月20日 現在)

4,018,986,586 円

3. 『ダイワ上場投信－東証REIT Core指数』の一口あたりの純資産額
(平成31年2月20日 現在)

1,081.643 円

4. 『ダイワ上場投信－東証REIT Core指数』の一口あたりの純資産額と
『東証REIT Core 指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成31年2月20日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成31年2月21日 現在)

[掲載番号:23]

ダイワ上場投信－東証REIT Core指数(設定ポートフォリオ)

本日をバスケット提示日とする追加設定日は下記のとおりですが、追加設定日前の受付日が受付停止日になっているため、バスケットの提示は行いません。

バスケット提示日 = 平成31年2月21日
追加設定日 = 平成31年2月27日